

Econometría Avanzada Parte II – 2025

Docentes

- Profesora: Mariana Marchionni (marchionni.mariana@gmail.com)
- Asistentes: Jessica Bracco (braccojessica@gmail.com), Ivana Benzaquen (ivanabenzaquen@gmail.com) y Luis Laguinge (luislaguinge4@gmail.com).

Objetivo

En esta parte del curso vamos a estudiar algunos modelos econométricos de uso extendido en microeconometría. En las clases se buscará familiarizar a los estudiantes con los aspectos conceptuales y teóricos de los distintos modelos y las opciones para su estimación, para que luego se enfrenten a las aplicaciones propuestas en los trabajos empíricos domiciliarios, donde podrán desarrollar la capacidad de identificar cuál es la herramienta econométrica adecuada para cada modelo particular y por qué.

Modalidad y fechas de clases

- **Teoría**
 - Son 5 clases presenciales: los martes 15 de julio, 5, 19 y 26 de agosto, y 2 de septiembre (el 12 de agosto es feriado), a las 17hs. Trataremos un tema por clase (ver temario debajo).
 - Como material complementario, para cada clase dispondrán de una presentación en pdf, videos y una guía de preguntas para ejercitación. Todo el material estará disponible en el Aula Virtual.
- **Práctica**
 - Las clases de práctica estarán disponibles en videos en el Aula Virtual.
 - Habrá clases de consulta virtuales y optativas los lunes 4/8, 25/8 y 8/9 a las 18:30hs por Zoom en este link: <https://zoom.us/j/94021877222>.

Evaluación

- La evaluación de esta parte del curso se compone de tres evaluaciones prácticas domiciliarias individuales y un examen final teórico presencial. Este último incluirá preguntas y ejercicios similares a los que figuran en las guías de preguntas disponibles en el aula virtual.
- Cada una de las evaluaciones (las tres prácticas y el examen final) debe aprobarse con una nota mínima de 6 (seis) puntos.
- La nota final de esta parte del curso se obtiene asignando un 50% al promedio simple de las tres evaluaciones prácticas domiciliarias y un 50% a la nota del examen final.
- Esta nota se promedia luego con la de la primera parte del curso para obtener la nota final de la materia.

Bibliografía básica

Los siguientes libros/papers son una fuente útil de consulta sobre los temas del curso:

- Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data; Wooldridge, J. (2010), MIT Press (WO)
- Econometric Analysis of Panel Data; Baltagi, B. (2005), 3rd edition, Wiley, New York. (BA)
- Microeconometrics: Methods and Applications; Cameron, A.C., and Trivedi, P.K. (2005), Cambridge University Press. (CT)
- Nonparametric Econometrics; Li, Q. and J. S. Racine (2007), Princeton University Press. (LR)
- Nonparametric Econometrics; Pagan, A. and Ullah (1999), Cambridge University Press. (PU)

Temario y cronograma

Clase	Tema	Bibliografía (libro, capítulo)	Evaluaciones individuales domiciliarias
Clase 1 (15/7)	Datos en paneles: modelo de componentes de errores. Estimador del modelo con efectos fijos: modelo con dummies por individuo y modelo within. Estimador del modelo con efectos aleatorios. Test de Hausman.	WO 10, BA 1&2	1. Modelos para datos en panel (sobre los temas de la clase 1). Entrega: 11/8.
Clase 2 (5/8)	Modelos con variable dependiente limitada: censura, truncamiento y variable dependiente binaria. Modelos de probabilidad lineal, modelos Probit y Logit. Interpretación, ventajas y limitaciones.	WO 15, 16 & 17	2. Selección muestral y censura (sobre los temas de las clases 2 y 3). Entrega: 1/9
Clase 3 (19/8)	Selectividad muestral. Distintos mecanismos de selectividad muestral y sus consecuencias sobre el sesgo del estimador de MCO. Sesgo de selección como error de especificación. Estimador de Heckman en dos etapas.	WO 17, CT 16	
Clase 4 (26/8)	Introducción a los métodos no-paramétricos. Estimación de densidades por el método de promedios ponderados o Kernels. Propiedades, elección óptima del ancho de banda. Estimadores con ancho de banda variable, estimación de densidades multivariadas. La maldición de la dimensionalidad.	LR 1, PU 2	3. Modelos no paramétricos (sobre los temas de las clases 4 y 5). Entrega: 15/9.
Clase 5 (2/9)	Estimación no paramétrica y semiparamétrica de regresiones. El estimador de Nadaraya-Watson. Estimadores locales lineales y polinómicos. Esperanza condicional parcialmente lineal.	PU 3, LR 2&6	
Examen final (9/9)	Examen presencial.		